

TALLER 4

Producto de entrega: Usted deberá entregar un notebook cuyo nombre es: *nombre_apellido_taller_4*. Este notebook deberá importar las bases de datos y en cada celda debe ejecutar los comandos que den respuesta a las preguntas que se muestran a continuación. Use markdown para escribir el título de la sección que contestará, así como para introducir comentarios de los resultados.

Problema 1

Estime un VAR usando el PIB agrícola (y_t), inflación (x_t), y el tipo de cambio real (z_t) para el Ecuador.

- a) Grafique las variables bajo estudio.
- b) dentifique el número de rezagos optimos
- c) Estime el VAR con lo número de rezagos en el literal b)
- d) Identifique los parámetros estructurales considerando

$$\begin{aligned}\varepsilon_{y_t} &= e_{y_t} \\ \varepsilon_{x_t} &= b_{21}e_{y_t} + e_{x_t} \\ \varepsilon_{z_t} &= b_{31}e_{y_t} + b_{32}e_{x_t} + e_{z_t}\end{aligned}$$

- e) Calcule las funciones impulso respuesta para 10 periodos
- f) Obtenga el pronóstico para los siguientes 5 periodos
- g) Obtenga la la descomposición de la varianza del error de pronóstico para los siguientes 5 periodos
- h) Realice la prueba de granger causality para probar la H_0 que inflación y la tasa de cambio real causan a PIB agrícola